

# 南方中证 500 交易型开放式指数证券投资 基金联接基金(LOF)2015 年年度报告

2015 年 12 月 31 日

基金管理人：南方基金管理有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

送出日期：2016 年 3 月 30 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2016 年 3 月 25 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告期自 2015 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>5</b>
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	6
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	7
<b>§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b> .....	<b>7</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	7
3.2 基金净值表现.....	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	9
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>9</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	12
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	12
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	13
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	13
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	14
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>14</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	14
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	14
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	14
<b>§6 审计报告</b> .....	<b>14</b>
6.1 审计报告基本信息.....	14
6.2 审计报告的基本内容.....	15
<b>§7 年度财务报表</b> .....	<b>16</b>
7.1 资产负债表.....	16
7.2 利润表.....	17
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	18
7.4 报表附注.....	19
<b>§8 投资组合报告</b> .....	<b>43</b>
8.1 期末基金资产组合情况.....	43
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	43
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	44
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	57
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	58
8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....	58

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细 .....	58
8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细 .....	59
8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细 .....	59
8.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细 .....	59
8.11 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....	59
8.12 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	59
8.13 投资组合报告附注 .....	59
<b>§9 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>60</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	60
9.2 期末上市基金前十名持有人 .....	60
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	61
9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况 .....	61
<b>§10 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>61</b>
<b>§11 重大事件揭示 .....</b>	<b>61</b>
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	61
11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 .....	61
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	62
11.4 基金投资策略的改变 .....	62
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	62
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	62
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	62
11.8 其他重大事件 .....	63
<b>§12 备查文件目录 .....</b>	<b>68</b>
12.1 备查文件目录 .....	68
12.2 存放地点 .....	69
12.3 查阅方式 .....	69

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	南方中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF)
基金简称	南方中证 500ETF 联接(LOF)
场内简称	南方 500
基金主代码	160119
前端交易代码	160119
后端交易代码	160120
基金运作方式	上市契约型开放式 (LOF)
基金合同生效日	2009 年 9 月 25 日
基金管理人	南方基金管理有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	3,157,946,424.77 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2009-11-11

注：本基金在交易所行情系统净值揭示等其他信息披露场合下，可简称为“南方 500”。

#### 2.1.1 目标基金基本情况

基金名称	中证500交易型开放式指数证券投资基金
基金主代码	510500
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2013年2月6日
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2013年3月15日
基金管理人名称	南方基金管理有限公司
基金托管人名称	中国农业银行股份有限公司

注：本基金在交易所行情系统净值揭示等其他信息披露场合下，可简称为“500ETF”

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金采用被动式指数化投资，通过严格的投资纪律约束和数量化的风险管理手段，以实现对标的指数的有效跟踪。
投资策略	本基金为完全被动式指数基金，原则上采用指数复制法，按照成份股在中证 500 指数中的基准权重构建指数化投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。当预期成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或因某些特殊情况导致流动性不足时，或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整，并辅之以金融衍生产品投资管理等，力争控制本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度不超过 0.3%，年跟踪误差不超过 4%。

业绩比较基准	中证 500 指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%
风险收益特征	本基金属股票基金，风险与收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。本基金为指数型基金，主要采用指数复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。

### 2.2.1 目标基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
投资策略	本基金为被动式指数基金，采用完全复制法，按照成份股在标的指数中的基准权重构建指数化投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为标的指数。本基金标的指数为中证 500 指数。
风险收益特征	本基金属股票基金，风险与收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。本基金采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		南方基金管理有限公司	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	鲍文革	林葛
	联系电话	0755-82763888	010-66060069
	电子邮箱	manager@southernfund.com	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		400-889-8899	95599
传真		0755-82763889	010-68121816
注册地址		深圳市福田区中心区福华一路六号免税商务大厦塔楼 31、32、33 层整层	北京东城区建国门内大街 69 号
办公地址		深圳市福田区中心区福华一路六号免税商务大厦塔楼 31、32、33 层整层	北京复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座 9 层
邮政编码		518048	100031
法定代表人		吴万善	刘士余

### 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报、上海证券报、证券时报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.nffund.com">http://www.nffund.com</a>
基金年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人的办公地址

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）	上海市湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

## § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2015 年	2014 年	2013 年
本期已实现收益	1,821,105,399.31	529,203,679.72	-352,187,101.50
本期利润	1,995,258,255.72	1,429,875,469.90	699,917,156.39
加权平均基金份额本期利润	0.7542	0.3225	0.1302
本期加权平均净值利润率	43.28%	31.28%	14.59%
本期基金份额净值增长率	44.14%	36.29%	16.05%
3.1.2 期末数据和指标	2015 年末	2014 年末	2013 年末
期末可供分配利润	2,501,740,805.17	273,188,993.37	-266,015,090.42
期末可供分配基金份额利润	0.7922	0.0859	-0.0571
期末基金资产净值	5,701,544,856.19	3,981,924,887.50	4,391,853,798.97
期末基金份额净值	1.8055	1.2526	0.9429
3.1.3 累计期末指标	2015 年末	2014 年末	2013 年末
基金份额累计净值增长率	96.99%	36.67%	0.28%

注：1. 本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2. 期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。

3. 所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

### 3.2 基金净值表现

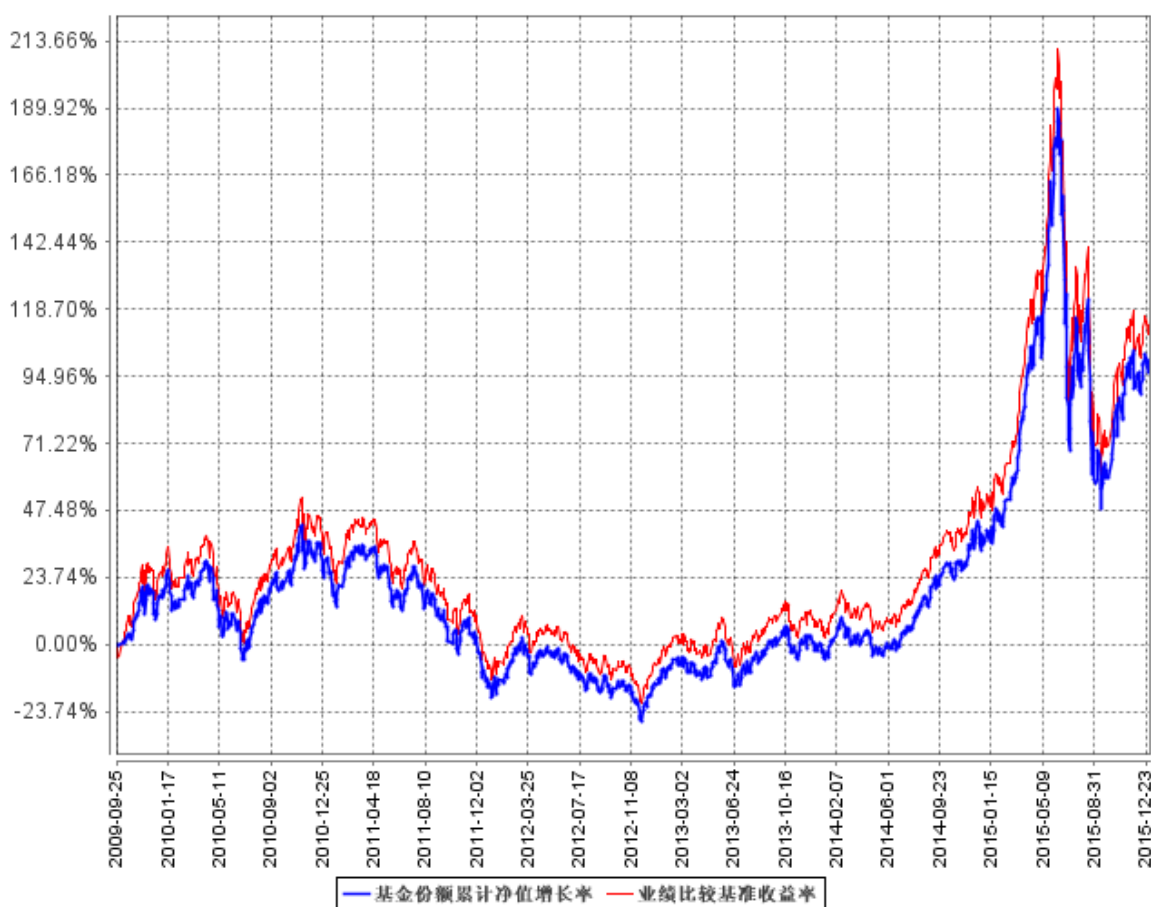
#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	23.56%	1.93%	23.13%	1.94%	0.43%	-0.01%
过去六个月	-12.18%	3.08%	-13.51%	3.07%	1.33%	0.01%

过去一年	44.14%	2.70%	41.26%	2.68%	2.88%	0.02%
过去三年	127.98%	1.87%	124.57%	1.86%	3.41%	0.01%
过去五年	53.12%	1.72%	52.59%	1.71%	0.53%	0.01%
自基金合同生效起至今	96.99%	1.72%	110.04%	1.72%	-13.05%	0.00%

### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

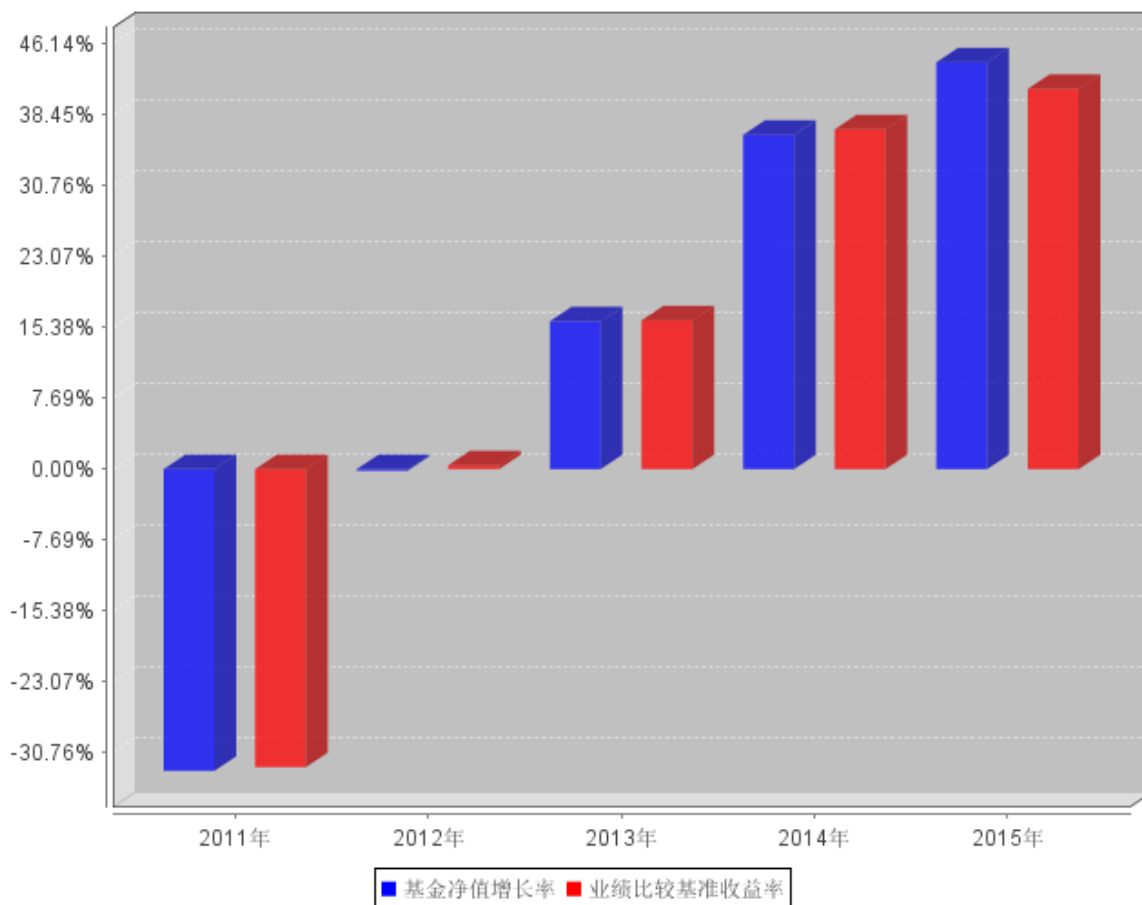
基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图





### 3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

年度	每 10 份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2015	-	-	-	-	
2014	0.3000	69,272,231.01	40,602,277.80	109,874,508.81	
2013	-	-	-	-	
合计	0.3000	69,272,231.01	40,602,277.80	109,874,508.81	

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

1998年3月6日，经中国证监会批准，南方基金管理有限公司作为国内首批规范的基金管理公司正式成立，成为我国“新基金时代”的起始标志。

南方基金总部设在深圳，注册资本 3 亿元人民币。股东结构为：华泰证券股份有限公司（45%）；深圳市投资控股有限公司（30%）；厦门国际信托有限公司（15%）；兴业证券股份有限公司（10%）。目前，公司在北京、上海、合肥、成都、深圳等地设有分公司，在香港和深圳前海设有子公司——南方东英资产管理有限公司（香港子公司）和南方资本管理有限公司（深圳子公司）。其中，南方东英是境内基金公司获批成立的第一家境外分支机构。

截至报告期末，南方基金管理有限公司（不含子公司）管理资产规模超过 5,000 亿元，旗下管理 85 只开放式基金，多个全国社保、企业年金和专户理财投资组合。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
罗文杰	本基金基金经理	2013 年 4 月 22 日	-	10 年	女，美国南加州大学数学金融硕士、美国加州大学计算机科学硕士，具有中国基金从业资格。曾先后任职于美国 Open Link Financial 公司、摩根斯坦利公司，从事量化分析工作。2008 年 9 月加入南方基金，任南方基金数量化投资部基金经理助理；2013 年 5 月至 2015 年 6 月，任南方策略基金经理；2013 年 4 月至今，任南方 500 基金经理；2013 年 4 月至今，任南方 500ETF 基金经理；2013 年 5 月至今，任南方 300 基金经理；2013 年 5 月至今，任南方开元沪深 300ETF 基金经理；2014 年 10 月至今，任 500 医药基金经理；2015 年 2 月至今，任南方恒生 ETF 基金经理。

注：1. 对基金的首任基金经理，其“任职日期”为基金合同生效日，“离职日期”为根据公司决定确定的解聘日期，除首任基金经理外，“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期；

2. 证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规、中国证监会和《南方中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF)》的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金持有人谋求最大

利益。本报告期内，基金运作整体合法合规，没有发生损害基金持有人利益的情形。基金的投资范围、投资比例符合有关法律法规及基金合同的规定。

### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

#### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和有关法律法规的规定，针对股票、债券的一级市场申购和二级市场交易等投资管理活动，以及授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的各个环节，建立了股票、债券、基金等证券池管理制度和细则，投资管理制度和细则，集中交易管理办法，公平交易操作指引，异常交易管理制度等公平交易相关的公司制度或流程指引。通过加强投资决策、交易执行的内部控制，完善对投资交易行为的日常监控和事后分析评估，以及履行相关的报告和信息披露义务，切实防范投资管理业务中的不公平交易和利益输送行为，保护投资者合法权益。

#### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，完善相应制度及流程，通过系统和人工等各种方式在各业务环节严格控制交易公平执行，公平对待旗下管理的所有基金和投资组合。

公司每季度对旗下组合进行股票和债券的同向交易价差专项分析。本报告期内，两两组合同单日、3日、5日时间窗口内同向交易买入溢价率均值或卖出溢价率均值显著不为0的情况不存在，并且交易占比也没有明显异常，未发现不公平对待各组合或组合间相互利益输送的情况。

#### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内不存在异常交易行为。本报告期内基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的交易次数为9次，其中5次是由于指数型基金根据标的指数成份股结构被动调仓所致，2次是由于指数型基金接受投资者申赎后被动增减仓位所致，2次是由于投资组合的投资策略需要，相关投资组合经理已提供决策依据并留存记录备查。

### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

#### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

报告期内，中证500指数大涨43.12%。

期间我们通过自建的“指数化交易系统”、“日内择时交易模型”、“跟踪误差归因分析系统”等，将本基金的跟踪误差指标控制在较好水平，并通过严格的风险管理流程，确保了本基金的安

全运作。

我们对本基金报告期内跟踪误差归因分析如下：

①接受申购赎回所带来的股票仓位偏离，对此我们通过日内择时交易争取跟踪误差最小化；

②本基金大额换购目标 ETF 所带来的成份股权重偏离，对此我们采取了优化的“再平衡”操作进行应对；

③报告期内指数成份股（包括调出指数成分股）的长期停牌，引起的成份股权重偏离及基金整体仓位的微小偏离；

④报告期内，我们根据指数每半年度成份股调整进行了基金调仓，事前我们制定了详细的调仓方案，在实施过程中引入多方校验机制防范风险发生，从实施结果来看，效果良好，跟踪误差控制在理想范围内。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

自本基金建仓完毕至报告期末年化跟踪误差为 0.651%，较好的完成了基金合同中控制年化跟踪误差不超过 4% 的投资目标。

截至报告期末，本基金份额净值为 1.8055 元，报告期内，份额净值增长率为 44.14%，同期业绩基准增长率为 41.26%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2016 年，国内经济结构转型、产业升级加速推进，预期利率水平仍下行，宽松货币政策逻辑不变，投资方面将导致资产配置荒。

本基金为指数基金，作为基金管理人，我们将通过严格的投资管理流程、精确的数量化计算、精益求精的工作态度、恪守指数化投资的宗旨，实现对标的指数的有效跟踪，为持有人提供与之相近的收益。投资者可以根据自身对证券市场的判断及投资风格，借助投资本基金参与市场。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，本基金管理人严格遵守相关法律法规，坚持一切从规范运作、防范风险、保护基金持有人利益出发，依照公司内部控制的整体要求，继续致力于内控机制的完善，加强内部风险的控制与防范，确保各项法规和管理制度的落实，保证基金合同得到严格履行。

本报告期内，本基金管理人开展了基金管理公司合规风险全面自查、分级基金折算自查等多项内控自查工作，制定或修订了合规手册、公平交易操作指引、股票池管理制度等内部制度，进一步完善了公司的内控体系；对公司投研交易、市场销售、后台运营等业务开展了定期或专项稽核，检查业务开展的合规性和制度执行的有效性；采取事前防范、事中控制和事后监督等三阶段

工作，加强对日常投资运作的管理和监控，督促投研交易业务的合规开展；针对新出台的法律法规和监管要求，积极组织多项法律法规、职业道德培训以及合规考试，不断提高从业人员的合规素质和职业道德修养；全面参与新产品设计、新业务拓展工作；严格审查基金宣传推介材料，及时检查基金销售业务的合法合规情况；完成各项信息披露工作，保证所披露信息的真实性、准确性和完整性；监督客户投诉处理，重视媒体监督和投资者关系管理。

本基金管理人承诺将坚持诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，积极健全内部管理制度，不断提高内部监察稽核工作的科学性和有效性，努力防范各种风险，切实保护基金资产的安全与利益。

#### 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证监会相关规定和基金合同约定，本基金管理人应严格按照新准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。会计师事务所在估值调整导致基金资产净值的变化在 0.25% 以上时对所采用的相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见并出具报告。定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。其中，本基金管理人为了确保估值工作的合规开展，建立了负责估值工作决策和执行的专门机构，组成人员包括副总经理、研究部总监、量化投资部总监、风险管理部总监及运作保障部总监等等。其中，超过三分之二以上的人员具有 10 年以上的基金从业经验，且具有风控、合规、会计方面的专业经验。基金经理可参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值价格的最终决策。本报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金合同约定，本基金的收益分配原则为：每一基金份额享有同等分配权；若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；基金收益分配后基金份额净值不能低于面值，即：基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值，基金收益分配基准日即期末可供分配利润计算截止日；在符合有关基金分红条件的前提下，基金收益分配每年最多 6 次，每次基金收益分配比例不得低于基金收益分配基准日可供分配利润的 10%；基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资。登记在注册登记系统基金份额持有人开放式基金账户下的基金份额，可选择现金红利或将现金红利按除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红。登记在证券登记结算系统基金份额持有人深圳证券账户下的基金份额，只能选择现金分红的方式，具体权益分配程序等有关事项遵循深圳证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司的相关规定；基金红利发放日距离收益分

配基准日的时间不超过 15 个工作日；法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

根据上述分配原则以及基金的实际运作情况，本报告期末有收益分配事项。

#### 4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人—南方基金管理有限公司 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

### 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本托管人认为，南方基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

### 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认为，南方基金管理有限公司的信息披露事务符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的本基金年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

## § 6 审计报告

### 6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2016)第 21226 号

## 6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告	
审计报告收件人	南方中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF)全体基金份额持有人	
引言段	我们审计了后附的南方中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF)(以下简称“南方中证 500ETF 联接基金”)的财务报表,包括 2015 年 12 月 31 日的资产负债表、2015 年度的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。	
管理层对财务报表的责任段	编制和公允列报财务报表是南方中证 500ETF 联接基金的基金管理人南方基金管理有限公司管理层的责任。这种责任包括: (1)按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表,并使其实现公允反映; (2)设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。	
注册会计师的责任段	我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则,计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。 审计工作涉及实施审计程序,以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断,包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时,注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制,以设计恰当的审计程序,但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性,以及评价财务报表的总体列报。 我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。	
审计意见段	我们认为,上述南方中证 500ETF 联接基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制,公允反映了南方中证 500ETF 联接基金 2015 年 12 月 31 日的财务状况以及 2015 年度的经营成果和基金净值变动情况。	
注册会计师的姓名	薛竞	陈熹
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)	
会计师事务所的地址	中国·上海市	
审计报告日期	2016 年 3 月 25 日	

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：南方中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF)

报告截止日：2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2015 年 12 月 31 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	7.4.7.1	312,791,396.95	216,003,083.01
结算备付金		5,734,853.96	-
存出保证金		2,001,495.02	436,003.20
交易性金融资产	7.4.7.2	5,408,919,840.57	3,783,668,765.15
其中：股票投资		104,562,309.34	25,800,381.58
基金投资		5,304,357,531.23	3,757,868,383.57
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		534,124.80	812,188.32
应收利息	7.4.7.5	60,591.71	33,960.90
应收股利		1,691.14	1,691.14
应收申购款		20,143,076.75	38,468,673.35
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	9,310,637.34	4,656,593.17
资产总计		5,759,497,708.24	4,044,080,958.24
<b>负债和所有者权益</b>			
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		30,657,468.08	11,124,804.26
应付赎回款		24,812,569.23	49,403,219.59
应付管理人报酬		184,258.05	118,664.57
应付托管费		36,851.62	23,732.93
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	2,067,139.53	919,878.53
应交税费		-	-



应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	194,565.54	565,770.86
负债合计		57,952,852.05	62,156,070.74
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	7.4.7.9	3,157,946,424.77	3,178,886,245.80
未分配利润	7.4.7.10	2,543,598,431.42	803,038,641.70
所有者权益合计		5,701,544,856.19	3,981,924,887.50
负债和所有者权益总计		5,759,497,708.24	4,044,080,958.24

注：报告截止日 2015 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.8055 元，基金份额总额 3,157,946,424.77 份。

## 7.2 利润表

会计主体：南方中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF)

本报告期：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>		2,005,591,047.27	1,437,552,748.30
1.利息收入		1,878,583.25	1,696,409.10
其中：存款利息收入	7.4.7.11	1,878,583.25	1,696,400.58
债券利息收入		-	8.52
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		1,820,732,725.54	530,741,876.32
其中：股票投资收益	7.4.7.12	66,919,799.94	33,760,092.17
基金投资收益	7.4.7.13	1,753,211,857.30	496,603,398.16
债券投资收益	7.4.7.14	-	3,357.48
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-	-
股利收益	7.4.7.16	601,068.30	375,028.51
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	174,152,856.41	900,671,790.18
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	8,826,882.07	4,442,672.70
<b>减：二、费用</b>		10,332,791.55	7,677,278.40

1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	1,672,376.11	1,504,552.44
2. 托管费	7.4.10.2.2	334,475.27	300,910.57
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.19	7,826,603.71	5,376,959.18
5. 利息支出		-	-
其中: 卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	7.4.7.20	499,336.46	494,856.21
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		1,995,258,255.72	1,429,875,469.90
减: 所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		1,995,258,255.72	1,429,875,469.90

### 7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体: 南方中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF)

本报告期: 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日

单位: 人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	3,178,886,245.80	803,038,641.70	3,981,924,887.50
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	1,995,258,255.72	1,995,258,255.72
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-20,939,821.03	-254,698,466.00	-275,638,287.03
其中: 1. 基金申购款	5,075,913,707.99	4,034,714,944.25	9,110,628,652.24
2. 基金赎回款	-5,096,853,529.02	-4,289,413,410.25	-9,386,266,939.27
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	3,157,946,424.77	2,543,598,431.42	5,701,544,856.19
项目	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日		

	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	4,657,868,889.39	-266,015,090.42	4,391,853,798.97
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	1,429,875,469.90	1,429,875,469.90
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-1,478,982,643.59	-250,947,228.97	-1,729,929,872.56
其中：1.基金申购款	3,791,220,069.61	45,492,966.62	3,836,713,036.23
2.基金赎回款	-5,270,202,713.20	-296,440,195.59	-5,566,642,908.79
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-109,874,508.81	-109,874,508.81
五、期末所有者权益（基金净值）	3,178,886,245.80	803,038,641.70	3,981,924,887.50

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

_____ 杨小松	_____ 徐超	_____ 徐超
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

南方中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF) (以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2009]755 号《关于核准南方中证 500 指数证券投资基金(LOF)募集的批复》核准,由南方基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《南方中证 500 指数证券投资基金(LOF)基金合同》负责公开募集。本基金为上市契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集 3,222,521,419.53 元,业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2009)第 187 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《南方中证 500 指数证券投资基金(LOF)基金合同》于 2009 年 9 月 25 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 3,223,217,818.45 份基金份额,其中认购资金利息折合 696,398.92 份基金份额。本基金的基金管理人为南方基金管理有限公司,基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

经深圳证券交易所(以下简称“深交所”)深证上字[2009]第 147 号文审核同意,本基金 581,411,748.00 份基金份额于 2009 年 11 月 11 日在深交所挂牌交易。未上市交易的基金份额托管在场外,基金份额持有人可通过跨系统转托管业务将其转至深交所场内后即可上市流通。

根据《南方中证 500 指数证券投资基金(LOF)基金合同》的有关约定,基金管理人经与基金托管人协商一致,将南方中证 500 指数证券投资基金(LOF)更名为南方中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF),并对《南方中证 500 指数证券投资基金(LOF)的基金合同》进行了修订,修订后的《南方中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF)基金合同》于 2013 年 2 月 22 日经中国证监会备案后生效。

本基金为中证 500 交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“目标 ETF”)的联接基金。目标 ETF 是采用完全复制法实现对中证 500 指数紧密跟踪的全被动指数基金,本基金主要通过投资于目标 ETF 实现对业绩比较基准的紧密跟踪,力争净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度不超过 0.3%,年跟踪误差不超过 4%。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《南方中证 500 指数证券投资基金(LOF)基金合同》的有关规定,于 2013 年 2 月 22 日前,本基金资产投资于具有良好流动性的金融工具,包括中证 500 指数的成份股及其备选成份股、新股(一级市场初次发行或增发)、债券以及中国证监会允许基金投资的其它金融工具。其中,中证 500 指数的成份股及其备选成份股的投资比例不低于基金资产净值的 90%,现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%,权证及其它金融工具的投资比例符合法律法规和监管机构的规定。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《南方中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF)基金合同》的有关规定,自 2013 年 2 月 22 日起,本基金的投资范围为目标 ETF、中证 500 指数成份股和备选成份股,本基金可少量投资于新股(一级市场初次发行或增发)、债券、及中国证监会允许基金投资的其它金融工具。本基金投资于目标 ETF 的比例不低于基金资产净值的 90%,基金保留的现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%,权证及其它金融工具的投资比例符合法律法规和监管机构的规定。本基金的业绩比较基准为:中证 500 指数收益率 X 95%+银行活期存款利率(税后) X 5%。

本财务报表由本基金的基金管理人南方基金管理有限公司于 2016 年 3 月 25 日批准报出。

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称

“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《南方中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF) 基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2015 年度财务报表符合企业会计准则的要求, 真实、完整地反映了本基金 2015 年 12 月 31 日的财务状况以及 2015 年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

#### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

#### 7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

#### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

##### (1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为: 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的基金投资、股票投资和债券投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项, 包括银行存款和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

##### (2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为: 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括其他各类应付款项等。

#### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时, 按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产, 取得时发生的相关交易费用计入当期损益;

对于支付的价款中包含的债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的基金投资、股票投资和债券投资按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

(2) 存在活跃市场的金融工具，如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。

(3) 当金融工具不存在活跃市场，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申

购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

#### 7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。基金投资在持有期间应取得的现金红利于除息日确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，其中场外基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资，场内基金份额持有人只能选择现金分红。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

#### 7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：（1）该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；（2）本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；（3）本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

#### 7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）等情况，本基金根据中国证监会公告[2008]38号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协（AMAC）基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法等估值技术进行估值。

### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

#### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

#### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

#### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

### 7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：



(1) 以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。基金买卖股票、债券的差价收入不予征收营业税。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，于 2015 年 9 月 8 日前暂减按 25% 计入应纳税所得额，自 2015 年 9 月 8 日起，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

## 7.4.7 重要财务报表项目的说明

### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末	上年度末
	2015 年 12 月 31 日	2014 年 12 月 31 日
活期存款	312,791,396.95	216,003,083.01
定期存款	-	-
其中：存款期限 1-3 个月	-	-
其他存款	-	-
合计：	312,791,396.95	216,003,083.01

### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末		
	2015 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	105,984,833.46	104,562,309.34	-1,422,524.12
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-

基金	4,014,888,887.11	5,304,357,531.23	1,289,468,644.12
其他	-	-	-
合计	4,120,873,720.57	5,408,919,840.57	1,288,046,120.00
项目	上年度末 2014年12月31日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	25,477,214.95	25,800,381.58	323,166.63
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	2,644,298,286.61	3,757,868,383.57	1,113,570,096.96
其他	-	-	-
合计	2,669,775,501.56	3,783,668,765.15	1,113,893,263.59

注：基金投资均为本基金持有的目标 ETF 的份额，按估值日目标 ETF 的份额净值确定公允价值。

本基金可采用股票组合申赎的方式或证券二级市场交易的方式进行目标 ETF 份额的买卖。

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末及上年度末未持有衍生金融资产/负债。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

本基金本报告期末及上年度末未持有买入返售金融资产。

#### 7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2015年12月31日	上年度末 2014年12月31日
应收活期存款利息	57,110.41	33,764.70
应收定期存款利息	-	-
应收其他存款利息	-	-
应收结算备付金利息	2,580.70	-
应收债券利息	-	-
应收买入返售证券利息	-	-
应收申购款利息	-	-
应收黄金合约拆借孳息	-	-
其他	900.60	196.20
合计	60,591.71	33,960.90

## 7.4.7.6 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 12 月 31 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
其他应收款	-	-
待摊费用	-	-
应收目标 ETF 可退替代款	6,023,432.82	1,101,041.41
应收目标 ETF 应退替代款	3,287,204.52	3,555,551.76
合计	9,310,637.34	4,656,593.17

## 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 12 月 31 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	2,067,139.53	919,878.53
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	2,067,139.53	919,878.53

## 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 12 月 31 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	91,565.54	158,770.86
预提费用	103,000.00	407,000.00
-	-	-
合计	194,565.54	565,770.86

## 7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	3,178,886,245.80	3,178,886,245.80
本期申购	5,075,913,707.99	5,075,913,707.99
本期赎回(以“-”号填列)	-5,096,853,529.02	-5,096,853,529.02
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-

本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	3,157,946,424.77	3,157,946,424.77

注：截至 2015 年 12 月 31 日止，本基金于深交所上市的基金份额为 32,689,049.00 份(2014 年 12 月 31 日：50,190,298.00 份)，托管在场外未上市交易的基金份额为 3,125,257,375.77 份(2014 年 12 月 31 日：3,128,695,947.80 份)。上市的基金份额登记在证券登记结算系统，可选择按市价流通或按基金份额净值申购或赎回；未上市的基金份额登记在注册登记系统，按基金份额净值申购或赎回。通过跨系统转登记可实现基金份额在两个系统之间的转换。

#### 7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	273,188,993.37	529,849,648.33	803,038,641.70
本期利润	1,821,105,399.31	174,152,856.41	1,995,258,255.72
本期基金份额交易产生的变动数	407,446,412.49	-662,144,878.49	-254,698,466.00
其中：基金申购款	2,733,628,434.23	1,301,086,510.02	4,034,714,944.25
基金赎回款	-2,326,182,021.74	-1,963,231,388.51	-4,289,413,410.25
本期已分配利润	-	-	-
本期末	2,501,740,805.17	41,857,626.25	2,543,598,431.42

#### 7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日	2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	1,750,364.61	1,637,834.17
定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	51,909.75	31,440.29
其他	76,308.89	27,126.12
合计	1,878,583.25	1,696,400.58

#### 7.4.7.12 股票投资收益

##### 7.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2015 年 1 月 1 日至 2015 年	2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12

	12 月 31 日	月 31 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	59,581,953.23	26,443,888.02
股票投资收益——赎回差价收入	-	-
股票投资收益——申购差价收入	7,337,846.71	7,316,204.15
合计	66,919,799.94	33,760,092.17

#### 7.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	2,856,553,181.65	1,930,349,714.10
减：卖出股票成本总额	2,796,971,228.42	1,903,905,826.08
买卖股票差价收入	59,581,953.23	26,443,888.02

#### 7.4.7.12.3 股票投资收益——申购差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日
申购基金份额总额	3,706,324,200.00	1,062,290,000.00
减：现金支付申购款总额	2,075,863,401.72	523,285,551.93
减：申购股票成本总额	1,623,122,951.57	531,688,243.92
申购差价收入	7,337,846.71	7,316,204.15

#### 7.4.7.13 基金投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日
卖出/赎回基金成交总额	4,222,760,380.04	3,399,716,160.59
减：卖出/赎回基金成本总额	2,469,548,522.74	2,903,112,762.43
基金投资收益	1,753,211,857.30	496,603,398.16

**7.4.7.14 债券投资收益**

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年 12月31日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月 31日
卖出债券、债转股及债券到期兑付成交金额	-	21,366.00
减：卖出债券成本总额	-	18,000.00
减：应收利息总额	-	8.52
买卖债券差价收入	-	3,357.48

**7.4.7.15 衍生工具收益**

本基金本报告期内及上年度可比期间无衍生工具收益。

**7.4.7.16 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年12 月31日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12 月31日
股票投资产生的股利收益	601,068.30	375,028.51
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	601,068.30	375,028.51

**7.4.7.17 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期 2015年1月1日至2015 年12月31日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年 12月31日
1. 交易性金融资产	174,152,856.41	900,671,790.18
——股票投资	-1,745,690.75	324,856.84
——债券投资	-	-
——基金投资	175,898,547.16	900,346,933.34
——资产支持证券投资	-	-
——贵金属投资	-	-
——其他	-	-
2. 衍生工具	-	-
——权证投资	-	-
3. 其他	-	-
合计	174,152,856.41	900,671,790.18

## 7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	8,826,882.07	4,442,672.70
其他	-	-
替代损益	-	-
合计	8,826,882.07	4,442,672.70

注：本基金的场内部分的赎回费率为 0.5%，场外部分的赎回费率按持有期间递减，不低于赎回费总额的 25% 归入基金资产。

## 7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日
交易所市场交易费用	7,826,603.71	5,376,959.18
银行间市场交易费用	-	-
合计	7,826,603.71	5,376,959.18

## 7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日
审计费用	103,000.00	107,000.00
信息披露费	300,000.00	300,000.00
上市费	60,000.00	60,000.00
银行汇划费	36,136.46	27,656.21
账户维护费	200.00	200.00
指数使用费	-	-
合计	499,336.46	494,856.21

注：指数使用费为支付标的指数供应商的标的指数许可使用费，按前一日基金资产净值的 0.02% 的年费率计提，逐日累计，按季支付。标的指数许可使用费的收取下限为每季(自然季度)人民币 50,000.00 元。

## 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

### 7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金并无须做披露的资产负债表日后事项。

## 7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
南方基金管理有限公司(“南方基金”)	基金管理人、基金销售机构
中国农业银行股份有限公司(“中国农业银行”)	基金托管人、基金销售机构
华泰证券股份有限公司(“华泰证券”)	基金管理人的股东、基金销售机构
兴业证券股份有限公司	基金管理人的股东、基金销售机构
厦门国际信托有限公司	基金管理人的股东
深圳市投资控股有限公司	基金管理人的股东
南方资本管理有限公司	基金管理人的子公司
南方东英资产管理有限公司	基金管理人的子公司
中证 500 交易型开放式指数证券投资基金(“目标 ETF”)	本基金的基金管理人管理的其他基金

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

## 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

#### 7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的 比例	成交金额	占当期股票 成交总额的 比例
华泰证券	1,389,150,677.14	24.87%	275,333,057.41	8.52%

#### 7.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未有通过关联方交易单元进行的权证交易。



### 7.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2015年1月1日至2015年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣 金总额的比例
华泰证券	457,238.73	10.57%	38,801.01	1.88%
关联方名称	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣 金总额的比例
华泰证券	243,643.39	8.35%	219,166.13	23.83%

注：1. 上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。

2. 该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

### 7.4.10.2 关联方报酬

#### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年12 月31日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31 日
	当期发生的基金应支付的管理费	1,672,376.11
其中：支付销售机构的客户维护费	5,051,560.26	5,723,981.32

注：本基金基金财产中投资于目标 ETF 的部分不收取管理费，支付基金管理人南方基金的管理人报酬按前一日基金资产净值扣除所持有目标 ETF 基金份额部分的基金资产后的余额（若为负数，则取零）的 0.5% 年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日管理人报酬} = (\text{前一日基金资产净值} - \text{前一日所持有目标 ETF 基金份额部分的基金资产}) \times 0.5\% / \text{当年天数}。$$

#### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年12 月31日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31 日
	当期发生的基金应支付	334,475.27

的托管费		
------	--	--

注：本基金基金财产中投资于目标 ETF 的部分不收取托管费，支付基金托管人 中国农业银行的托管费按前一日基金资产净值扣除所持有目标 ETF 基金份额部分的基金资产后的余额（若为负数，则取零）的 0.1% 年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费 = (前一日基金资产净值 - 前一日所持有目标 ETF 基金份额部分的基金资产) × 0.1% / 当年天数。

#### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

#### 7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期	上年度可比期间
	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日	2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日
基金合同生效日（2009 年 9 月 25 日）持有的基金份额	-	-
期初持有的基金份额	38,304,604.31	-
期间申购/买入总份额	14,869,173.42	38,304,604.31
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	299,805.00	-
期末持有的基金份额	52,873,972.73	38,304,604.31
期末持有的基金份额占基金总份额比例	1.6700%	1.2100%

注：1. 基金管理人南方基金在本年度申购本基金的交易委托华泰证券办理，适用费率为每笔人民币 1,000.00 元。

2. 基金管理人南方基金在本年度非交易过户本基金的交易委托杭州数米网科技有限公司办理，未产生手续费。

##### 7.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末		上年度末	
	2015 年 12 月 31 日		2014 年 12 月 31 日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例

华泰证券	179,549.11	0.0100%	1,216,901.00	0.0400%
------	------------	---------	--------------	---------

注：华泰证券投资本基金相关的费用按基金合同和更新的招募说明书的有关规定以及与券商约定的席位佣金费率支付。

#### 7.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2015年1月1日至2015年12月31日		2014年1月1日至2014年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国农业银行	312,791,396.95	1,750,364.61	216,003,083.01	1,637,834.17

注：本基金的银行存款由基金托管人中国农业银行保管，按银行同业利率计息。

#### 7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销的证券。

#### 7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

于2015年12月31日，本基金持有675,473,402份目标ETF基金份额，占其总份额的比例为25.91%（于2014年12月31日，本基金持有2,519,016,211份目标ETF基金份额，占其总份额的比例为79.56%）。

#### 7.4.11 利润分配情况

##### 7.4.11.1 利润分配情况——非货币市场基金

本基金本报告期内无利润分配。

#### 7.4.12 期末（2015年12月31日）本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末及上年度末未持有因认购新发/增发证券流通受限证券。

##### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
600978	宜华木业	2015年6月18日	重大资产重组	22.33	2016年1月21日	20.10	117,900	2,632,707.00	2,632,707.00	-
600654	中安消	2015年12月14日	重大事项	28.84	-	-	55,900	1,742,284.70	1,612,156.00	-
600729	重庆百货	2015年7月24日	重大资产重组	29.26	2016年1月4日	29.90	32,000	1,036,480.00	936,320.00	-
002049	同方	2015年12	重大资	60.15	2016年3	54.14	12,060	617,885.78	725,409.00	-

	国芯	月 11 日	产重组		月 11 日						
601717	郑煤机	2015 年 12 月 18 日	重大资产重组	7.52	-	-	93,400	697,332.59	702,368.00	-	
002219	恒康医疗	2015 年 7 月 8 日	重大资产重组	14.90	-	-	33,250	521,360.00	495,425.00	-	
300088	长信科技	2015 年 12 月 14 日	重大资产重组	14.03	2016 年 2 月 29 日	12.63	34,500	410,025.31	484,035.00	-	
600120	浙江东方	2015 年 10 月 12 日	重大资产重组	19.86	-	-	22,200	440,892.00	440,892.00	-	
002340	格林美	2015 年 12 月 29 日	重大事项	15.20	2016 年 1 月 6 日	14.35	28,167	421,500.92	428,138.40	-	
002048	宁波华翔	2015 年 11 月 19 日	重大资产重组	17.40	-	-	23,900	397,987.72	415,860.00	-	
600699	均胜电子	2015 年 11 月 4 日	重大资产重组	31.25	2016 年 3 月 10 日	29.00	12,000	375,000.00	375,000.00	-	
000028	国药一致	2015 年 10 月 21 日	重大资产重组	69.71	-	-	5,138	351,866.65	358,169.98	-	
601000	唐山港	2015 年 10 月 29 日	重大资产重组	8.25	2016 年 2 月 17 日	7.98	42,000	346,500.00	346,500.00	-	
002143	印纪传媒	2015 年 12 月 9 日	重大事项	40.55	2016 年 1 月 5 日	36.50	8,500	259,154.88	344,675.00	-	
600645	中源协和	2015 年 12 月 30 日	重大事项	65.01	2016 年 1 月 4 日	63.90	5,300	352,095.84	344,553.00	-	
000829	天音控股	2015 年 11 月 9 日	重大资产重组	12.22	-	-	25,200	285,944.94	307,944.00	-	
600851	海欣股份	2015 年 12 月 21 日	重大资产重组	14.70	2016 年 1 月 19 日	13.23	17,036	249,853.96	250,429.20	-	
600864	哈投股份	2015 年 10 月 9 日	重大资产重组	10.88	2016 年 1 月 14 日	11.97	22,200	241,536.00	241,536.00	-	
002011	盾安环境	2015 年 12 月 28 日	重大事项	16.72	2016 年 2 月 22 日	15.05	14,000	230,249.00	234,080.00	-	
000426	兴业矿业	2015 年 10 月 28 日	重大资产重组	7.06	2016 年 3 月 21 日	7.77	29,500	191,385.00	208,270.00	-	
600859	王府井	2015 年 12 月 21 日	重大事项	27.22	2016 年 1 月 4 日	27.22	6,900	187,367.59	187,818.00	-	
002698	博实股份	2015 年 12 月 28 日	重大事项	29.33	2016 年 1 月 5 日	26.40	5,610	164,700.99	164,541.30	-	
000982	中银绒业	2014 年 8 月 25 日	重大事项	4.64	2016 年 2 月 25 日	5.10	34,738	150,317.69	161,184.32	-	
300043	互动娱乐	2015 年 12 月 17 日	重大事项	15.80	-	-	9,100	140,810.35	143,780.00	-	
002371	七星电子	2015 年 10 月 8 日	重大事项	19.28	2016 年 1 月 11 日	21.21	7,200	214,873.92	138,816.00	-	

600282	南钢股份	2015年12月30日	重大事项	3.17	2016年1月12日	3.24	39,300	124,056.02	124,581.00	-
601678	滨化股份	2015年12月31日	重大事项	8.02	2016年1月5日	7.22	13,600	110,194.73	109,072.00	-
000973	佛塑科技	2015年12月18日	重大事项	13.00	2016年2月22日	11.70	5,300	50,118.65	68,900.00	-
600880	博瑞传播	2015年9月16日	重大资产重组	11.37	2016年1月18日	8.25	900	10,168.73	10,233.00	-
002678	珠江钢琴	2015年12月21日	重大事项	17.21	2016年1月19日	15.49	67	1,101.07	1,153.07	-
000748	长城信息	2015年6月18日	重大资产重组	34.88	2016年3月10日	31.39	32	884.49	1,116.16	-

注：本基金截至 2015 年 12 月 31 日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

本基金本报告期末及上年度末无从事债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

## 7.4.13 金融工具风险及管理

### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金属于交易型开放式指数证券投资基金联接基金，风险与收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。本基金为被动式指数型基金，紧密跟踪标的指数，具有和标的指数以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征，属于证券投资基金中风险较高、收益较高的品种。本基金投资的金融工具主要包括基金投资和股票投资。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“紧密跟踪业绩比较基准，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化”的风险收益目标。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以风险控制委员会为核心的、由督察长、风险控制委员会、监察稽核部、风险管理部和相关业务部门构成的四级风险管理架构体系。本基金的基金管理人在董事会下设立风险管理委员会，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等；在管理层层面设立风险控制委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；在业务操作层面风险管理职责主要由监察稽核部和风险管理部负责，协调并与各部门合作完成运作风险管理以及进行投资风险分析与绩效评估，督察长负责组织指导监察稽核工作。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去

估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

#### 7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国农业银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险。信用等级评估以内部信用评级为主，外部信用评级为辅。内部债券信用评级主要考察发行人的经营风险、财务风险和流动性风险，以及信用产品的条款和担保人的情况等。此外，本基金的基金管理人根据信用产品的内部评级，通过单只信用产品投资占基金资产净值的比例及占发行量的比例进行控制，通过分散化投资以分散信用风险。

于 2015 年 12 月 31 日，本基金未持有除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券(2014 年 12 月 31 日：同)。

#### 7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变

现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金所持目标 ETF 份额能通过股票组合赎回或二级市场交易卖出,所持股票均在证券交易所上市,因此除附注 7.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外,其余均能根据本基金的基金管理人的投资意图,以合理价格适时变现。

于 2015 年 12 月 31 日,本基金所承担的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息,可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息,因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

#### 7.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险,包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

##### 7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险,其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控,并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息,因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金及存出保证金等。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位:人民币元

本期末 2015 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	312,791,396.95	-	-	-	312,791,396.95
结算备付金	5,734,853.96	-	-	-	5,734,853.96
存出保证金	2,001,495.02	-	-	-	2,001,495.02
交易性金融资产	-	-	-	5,408,919,840.57	5,408,919,840.57
应收证券清算款	-	-	-	534,124.80	534,124.80
应收利息	-	-	-	60,591.71	60,591.71
应收股利	-	-	-	1,691.14	1,691.14

应收申购款	18,663,416.49	-	-	1,479,660.26	20,143,076.75
其他资产	-	-	-	9,310,637.34	9,310,637.34
资产总计	339,191,162.42	-	-	5,420,306,545.82	5,759,497,708.24
负债					
应付证券清算款	-	-	-	30,657,468.08	30,657,468.08
应付赎回款	-	-	-	24,812,569.23	24,812,569.23
应付管理人报酬	-	-	-	184,258.05	184,258.05
应付托管费	-	-	-	36,851.62	36,851.62
应付交易费用	-	-	-	2,067,139.53	2,067,139.53
其他负债	-	-	-	194,565.54	194,565.54
负债总计	-	-	-	57,952,852.05	57,952,852.05
利率敏感度缺口	339,191,162.42	-	-	5,362,353,693.77	5,701,544,856.19
上年度末 2014 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	216,003,083.01	-	-	-	216,003,083.01
存出保证金	436,003.20	-	-	-	436,003.20
交易性金融资产	-	-	-	3,783,668,765.15	3,783,668,765.15
应收证券清算款	-	-	-	812,188.32	812,188.32
应收利息	-	-	-	33,960.90	33,960.90
应收股利	-	-	-	1,691.14	1,691.14
应收申购款	35,340,520.12	-	-	3,128,153.23	38,468,673.35
其他资产	-	-	-	4,656,593.17	4,656,593.17
资产总计	251,779,606.33	-	-	3,792,301,351.91	4,044,080,958.24
负债					
应付证券清算款	-	-	-	11,124,804.26	11,124,804.26
应付赎回款	-	-	-	49,403,219.59	49,403,219.59
应付管理人报酬	-	-	-	118,664.57	118,664.57
应付托管费	-	-	-	23,732.93	23,732.93
应付交易费用	-	-	-	919,878.53	919,878.53
其他负债	-	-	-	565,770.86	565,770.86
负债总计	-	-	-	62,156,070.74	62,156,070.74
利率敏感度缺口	251,779,606.33	-	-	3,730,145,281.17	3,981,924,887.50

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2015 年 12 月 31 日，本基金未持有交易性债券投资，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(2014 年 12 月 31 日：同)。



#### 7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于能通过股票组合赎回或二级市场交易卖出的目标 ETF 份额以及证券交易所上市的股票，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金通过把全部或接近全部的基金资产投资于目标 ETF、标的指数成份股和备选成份股进行被动式指数化投资，正常情况下投资于目标 ETF 的比例不低于基金资产净值的 90%；本基金投资于目标 ETF 的方式以申购和赎回为主，但在目标 ETF 二级市场流动性较好的情况下，为了更好地实现本基金的投资目标，也可以通过二级市场交易买卖目标 ETF；除流动性管理所需以外，本基金对于目标 ETF 以外的证券投资倾向采用被动式指数化投资。本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

##### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 12 月 31 日		上年度末 2014 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产-股票投资	104,562,309.34	1.83	25,800,381.58	0.65
交易性金融资产-基金投资	5,304,357,531.23	93.03	3,757,868,383.57	94.37
交易性金融资产-债券投资	-	-	-	-
交易性金融资产-贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	5,408,919,840.57	94.86	3,783,668,765.15	95.02

注：交易性金融资产-基金投资为本基金投资的目标 ETF 份额。

##### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除中证 500 指数以外的其他市场变量保持不变	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的

		影响金额（单位：人民币万元）	
		本期末（2015 年 12 月 31 日）	上年度末（2014 年 12 月 31 日）
	1. 中证 500 指数上升 5%	增加 27,203.00	增加 18,965.00
	2. 中证 500 指数下降 5%	减少 27,203.00	减少 18,965.00

#### 7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### (1) 公允价值

##### (a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

##### (b) 持续的以公允价值计量的金融工具

##### (i) 各层次金融工具公允价值

于 2015 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 5,395,924,178.14 元，属于第二层次的余额为 12,995,662.43 元，无属于第三层次的余额(2014 年 12 月 31 日：第一层次 3,771,637,598.48 元，第二层次 12,031,166.67 元，无属于第三层次余额)。

##### (ii) 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票公允价值应属第二层次还是第三层次。

##### (iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

##### (c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2015 年 12 月 31 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2014 年 12 月 31 日：同)。

##### (d) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(2)除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 8 投资组合报告

### 8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	104,562,309.34	1.82
	其中：股票	104,562,309.34	1.82
2	基金投资	5,304,357,531.23	92.10
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	318,526,250.91	5.53
8	其他各项资产	32,051,616.76	0.56
9	合计	5,759,497,708.24	100.00

### 8.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	2,134,857.28	0.04
B	采矿业	3,171,060.32	0.06
C	制造业	61,976,307.01	1.09
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,242,515.66	0.06
E	建筑业	2,586,005.37	0.05
F	批发和零售业	6,668,042.73	0.12
G	交通运输、仓储和邮政业	2,702,714.00	0.05
H	住宿和餐饮业	220,676.00	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务	8,025,086.22	0.14

	业		
J	金融业	1,001,946.50	0.02
K	房地产业	6,848,500.84	0.12
L	租赁和商务服务业	2,216,571.07	0.04
M	科学研究和技术服务业	439,110.50	0.01
N	水利、环境和公共设施管理业	791,564.52	0.01
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	308,966.22	0.01
R	文化、体育和娱乐业	1,281,584.78	0.02
S	综合	946,800.32	0.02
	合计	104,562,309.34	1.83

### 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	600978	宜华木业	117,900	2,632,707.00	0.05
2	600654	中安消	55,900	1,612,156.00	0.03
3	600729	重庆百货	32,000	936,320.00	0.02
4	002049	同方国芯	12,060	725,409.00	0.01
5	601717	郑煤机	93,400	702,368.00	0.01
6	002405	四维图新	15,700	609,160.00	0.01
7	002466	天齐锂业	4,300	605,225.00	0.01
8	002030	达安基因	12,740	524,633.20	0.01
9	002004	华邦健康	36,400	515,060.00	0.01
10	002439	启明星辰	16,068	514,176.00	0.01
11	002400	省广股份	20,000	503,000.00	0.01
12	002219	恒康医疗	33,250	495,425.00	0.01
13	300088	长信科技	34,500	484,035.00	0.01
14	000566	海南海药	12,100	470,206.00	0.01
15	002276	万马股份	15,600	469,560.00	0.01
16	002368	太极股份	6,916	464,063.60	0.01
17	002701	奥瑞金	16,300	460,638.00	0.01
18	000997	新大陆	18,140	459,304.80	0.01
19	000998	隆平高科	19,300	458,375.00	0.01

20	300253	卫宁软件	10,600	443,928.00	0.01
21	600120	浙江东方	22,200	440,892.00	0.01
22	000887	中鼎股份	18,500	436,600.00	0.01
23	002340	格林美	28,167	428,138.40	0.01
24	600201	生物股份	11,400	421,458.00	0.01
25	002048	宁波华翔	23,900	415,860.00	0.01
26	600816	安信信托	17,850	406,444.50	0.01
27	600160	巨化股份	17,300	406,031.00	0.01
28	002308	威创股份	16,200	399,330.00	0.01
29	000078	海王生物	16,643	398,766.28	0.01
30	002573	清新环境	17,708	397,367.52	0.01
31	000930	中粮生化	26,700	394,626.00	0.01
32	002191	劲嘉股份	25,500	391,680.00	0.01
33	000012	南玻 A	29,000	387,150.00	0.01
34	000718	苏宁环球	29,340	386,994.60	0.01
35	600635	大众公用	39,100	385,526.00	0.01
36	002085	万丰奥威	11,900	382,942.00	0.01
37	600079	人福医药	17,153	381,825.78	0.01
38	000547	航天发展	19,800	377,190.00	0.01
39	300182	捷成股份	15,670	376,080.00	0.01
40	600699	均胜电子	12,000	375,000.00	0.01
41	000511	烯碳新材	31,900	373,549.00	0.01
42	300257	开山股份	11,900	367,115.00	0.01
43	002161	远望谷	16,400	365,720.00	0.01
44	300072	三聚环保	10,740	364,837.80	0.01
45	000988	华工科技	17,200	364,296.00	0.01
46	000656	金科股份	68,600	362,208.00	0.01
47	000028	国药一致	5,138	358,169.98	0.01
48	000031	中粮地产	25,100	352,655.00	0.01
49	002657	中科金财	4,400	351,956.00	0.01
50	600503	华丽家族	25,500	349,350.00	0.01
51	000661	长春高新	2,900	349,305.00	0.01
52	300291	华录百纳	9,800	348,880.00	0.01
53	002444	巨星科技	16,800	347,760.00	0.01
54	601000	唐山港	42,000	346,500.00	0.01
55	000697	炼石有色	12,400	344,968.00	0.01
56	002143	印纪传媒	8,500	344,675.00	0.01
57	600645	中源协和	5,300	344,553.00	0.01
58	600158	中体产业	13,100	341,648.00	0.01

59	002273	水晶光电	8,400	341,040.00	0.01
60	600673	东阳光科	33,400	340,346.00	0.01
61	600643	爱建集团	23,000	336,950.00	0.01
62	600522	中天科技	14,700	336,630.00	0.01
63	600482	风帆股份	7,100	334,055.00	0.01
64	000970	中科三环	23,600	331,108.00	0.01
65	000050	深天马 A	15,600	330,876.00	0.01
66	600525	长园集团	17,511	329,732.13	0.01
67	002022	科华生物	11,300	328,830.00	0.01
68	000690	宝新能源	33,400	326,652.00	0.01
69	002489	浙江永强	30,050	325,742.00	0.01
70	000671	阳光城	36,050	325,531.50	0.01
71	600655	豫园商城	20,100	324,816.00	0.01
72	300085	银之杰	5,800	324,220.00	0.01
73	600410	华胜天成	12,200	323,422.00	0.01
74	300147	香雪制药	12,810	320,378.10	0.01
75	300122	智飞生物	8,800	320,144.00	0.01
76	000592	平潭发展	16,000	319,680.00	0.01
77	000541	佛山照明	19,000	317,300.00	0.01
78	002179	中航光电	8,300	315,068.00	0.01
79	002271	东方雨虹	16,112	314,667.36	0.01
80	002266	浙富控股	38,300	311,762.00	0.01
81	000616	海航投资	39,500	310,470.00	0.01
82	600436	片仔癀	4,500	309,555.00	0.01
83	002223	鱼跃医疗	8,044	309,291.80	0.01
84	300244	迪安诊断	4,443	308,966.22	0.01
85	300055	万邦达	14,200	308,282.00	0.01
86	002665	首航节能	10,100	308,050.00	0.01
87	000829	天音控股	25,200	307,944.00	0.01
88	002073	软控股份	18,063	305,264.70	0.01
89	600694	大商股份	5,900	304,617.00	0.01
90	002250	联化科技	16,127	304,316.49	0.01
91	300199	翰宇药业	12,300	302,949.00	0.01
92	002325	洪涛股份	19,375	302,831.25	0.01
93	002595	豪迈科技	13,300	301,777.00	0.01
94	002508	老板电器	6,700	301,165.00	0.01
95	000006	深振业 A	26,100	300,411.00	0.01
96	000939	凯迪生态	20,800	299,520.00	0.01
97	300274	阳光电源	10,900	298,878.00	0.01

98	002390	信邦制药	20,800	298,480.00	0.01
99	600388	龙净环保	17,000	293,760.00	0.01
100	600879	航天电子	16,400	293,068.00	0.01
101	000681	视觉中国	7,700	292,677.00	0.01
102	002013	中航机电	12,910	292,540.60	0.01
103	600498	烽火通信	10,080	287,380.80	0.01
104	300267	尔康制药	8,500	285,600.00	0.01
105	600074	保千里	17,300	284,931.00	0.00
106	000667	美好集团	56,600	280,736.00	0.00
107	002373	千方科技	6,100	279,075.00	0.00
108	002063	远光软件	13,163	278,265.82	0.00
109	600376	首开股份	22,200	277,500.00	0.00
110	600487	亨通光电	17,400	277,356.00	0.00
111	000762	西藏矿业	10,500	276,150.00	0.00
112	601168	西部矿业	37,300	275,647.00	0.00
113	600664	哈药股份	22,962	273,936.66	0.00
114	002498	汉缆股份	36,800	273,792.00	0.00
115	300273	和佳股份	13,100	273,790.00	0.00
116	002005	德豪润达	27,000	273,780.00	0.00
117	600770	综艺股份	14,900	272,223.00	0.00
118	002642	荣之联	4,700	272,083.00	0.00
119	600478	科力远	12,400	271,808.00	0.00
120	002299	圣农发展	12,300	270,477.00	0.00
121	600138	中青旅	11,600	270,396.00	0.00
122	000777	中核科技	8,500	266,815.00	0.00
123	002217	合力泰	15,700	266,115.00	0.00
124	000926	福星股份	15,800	266,072.00	0.00
125	600601	方正科技	43,000	265,740.00	0.00
126	002001	新和成	15,100	263,344.00	0.00
127	601929	吉视传媒	42,600	263,268.00	0.00
128	001696	宗申动力	19,000	262,580.00	0.00
129	601012	隆基股份	19,200	262,080.00	0.00
130	000816	智慧农业	31,400	261,876.00	0.00
131	600312	平高电气	13,400	261,300.00	0.00
132	600881	亚泰集团	36,000	260,640.00	0.00
133	600143	金发科技	30,300	260,580.00	0.00
134	600516	方大炭素	20,800	260,208.00	0.00
135	002285	世联行	16,000	259,680.00	0.00
136	002050	三花股份	24,300	258,795.00	0.00

137	000563	陕国投 A	17,100	258,552.00	0.00
138	600418	江淮汽车	17,700	258,243.00	0.00
139	300115	长盈精密	7,656	257,011.92	0.00
140	600500	中化国际	20,000	256,200.00	0.00
141	002428	云南锗业	12,600	255,528.00	0.00
142	600240	华业资本	16,972	255,428.60	0.00
143	600797	浙大网新	17,700	254,526.00	0.00
144	600594	益佰制药	12,000	254,400.00	0.00
145	600499	科达洁能	11,200	253,456.00	0.00
146	000650	仁和药业	23,955	253,204.35	0.00
147	002168	深圳惠程	21,400	253,162.00	0.00
148	000732	泰禾集团	10,300	252,350.00	0.00
149	600611	大众交通	16,400	251,740.00	0.00
150	000543	皖能电力	29,720	251,728.40	0.00
151	600198	大唐电信	10,200	251,634.00	0.00
152	600521	华海药业	9,889	251,081.71	0.00
153	600851	海欣股份	17,036	250,429.20	0.00
154	002714	牧原股份	5,304	249,659.28	0.00
155	000587	金叶珠宝	11,700	248,625.00	0.00
156	002437	誉衡药业	8,100	245,025.00	0.00
157	000021	深科技	20,300	244,818.00	0.00
158	300202	聚龙股份	7,600	244,644.00	0.00
159	002477	雏鹰农牧	14,400	243,504.00	0.00
160	000758	中色股份	16,300	242,544.00	0.00
161	002440	闰土股份	12,700	241,935.00	0.00
162	600864	哈投股份	22,200	241,536.00	0.00
163	000861	海印股份	31,090	240,325.70	0.00
164	600017	日照港	36,700	240,018.00	0.00
165	002244	滨江集团	29,900	238,004.00	0.00
166	002344	海宁皮城	15,500	237,770.00	0.00
167	002311	海大集团	16,960	236,931.20	0.00
168	002092	中泰化学	26,900	236,720.00	0.00
169	002269	美邦服饰	34,950	234,514.50	0.00
170	000860	顺鑫农业	11,000	234,300.00	0.00
171	300026	红日药业	11,100	234,210.00	0.00
172	002011	盾安环境	14,000	234,080.00	0.00
173	000685	中山公用	16,360	231,494.00	0.00
174	002309	中利科技	12,292	230,843.76	0.00
175	600108	亚盛集团	30,900	226,806.00	0.00



176	002603	以岭药业	12,500	226,625.00	0.00
177	600325	华发股份	13,871	226,097.30	0.00
178	600704	物产中大	12,800	225,536.00	0.00
179	600967	北方创业	12,700	225,425.00	0.00
180	600094	大名城	21,200	225,144.00	0.00
181	002221	东华能源	9,600	224,448.00	0.00
182	600811	东方集团	25,812	224,048.16	0.00
183	002672	东江环保	11,100	223,887.00	0.00
184	600884	杉杉股份	5,700	223,668.00	0.00
185	002681	奋达科技	5,100	222,870.00	0.00
186	600171	上海贝岭	10,500	222,495.00	0.00
187	600176	中国巨石	8,721	221,600.61	0.00
188	600754	锦江股份	4,300	220,676.00	0.00
189	000488	晨鸣纸业	24,630	219,699.60	0.00
190	600497	驰宏锌锗	19,896	219,651.84	0.00
191	000062	深圳华强	6,000	219,600.00	0.00
192	600755	厦门国贸	23,422	218,293.04	0.00
193	002051	中工国际	8,600	217,838.00	0.00
194	600511	国药股份	5,742	217,736.64	0.00
195	600151	航天机电	17,600	217,536.00	0.00
196	600422	昆药集团	5,459	217,377.38	0.00
197	002180	艾派克	4,700	216,905.00	0.00
198	600787	中储股份	21,600	216,864.00	0.00
199	300134	大富科技	7,200	216,720.00	0.00
200	600536	中国软件	6,000	216,480.00	0.00
201	002396	星网锐捷	8,950	216,142.50	0.00
202	600380	健康元	15,300	211,446.00	0.00
203	000600	建投能源	19,800	211,068.00	0.00
204	600528	中铁二局	14,700	210,651.00	0.00
205	002064	华峰氨纶	32,400	210,276.00	0.00
206	002190	成飞集成	4,800	210,048.00	0.00
207	000680	山推股份	27,400	209,610.00	0.00
208	002463	沪电股份	32,400	209,304.00	0.00
209	002588	史丹利	6,427	209,070.31	0.00
210	000426	兴业矿业	29,500	208,270.00	0.00
211	600587	新华医疗	5,700	207,081.00	0.00
212	000848	承德露露	12,500	206,250.00	0.00
213	000979	中弘股份	51,020	204,080.00	0.00
214	000897	津滨发展	35,800	204,060.00	0.00

215	000652	泰达股份	28,600	203,918.00	0.00
216	000572	海马汽车	31,791	203,462.40	0.00
217	600835	上海机电	6,700	203,077.00	0.00
218	002505	大康牧业	23,900	202,911.00	0.00
219	002181	粤传媒	12,800	202,880.00	0.00
220	002482	广田股份	6,931	202,731.75	0.00
221	002414	高德红外	6,600	201,102.00	0.00
222	600597	光明乳业	12,621	200,926.32	0.00
223	600435	北方导航	7,000	200,900.00	0.00
224	600064	南京高科	10,600	200,870.00	0.00
225	000090	天健集团	11,800	200,836.00	0.00
226	600316	洪都航空	8,600	200,724.00	0.00
227	600651	飞乐音响	13,600	200,600.00	0.00
228	000961	中南建设	12,900	199,434.00	0.00
229	000603	盛达矿业	11,000	198,550.00	0.00
230	000513	丽珠集团	3,440	197,559.20	0.00
231	002345	潮宏基	11,700	197,496.00	0.00
232	002551	尚荣医疗	5,979	197,127.63	0.00
233	000830	鲁西化工	28,310	196,188.30	0.00
234	603766	隆鑫通用	8,250	195,772.50	0.00
235	600320	振华重工	32,714	195,302.58	0.00
236	002653	海思科	8,920	195,258.80	0.00
237	600169	太原重工	33,700	193,438.00	0.00
238	000049	德赛电池	3,400	193,052.00	0.00
239	600058	五矿发展	8,500	192,950.00	0.00
240	300039	上海凯宝	13,800	191,268.00	0.00
241	600517	置信电气	15,100	191,166.00	0.00
242	002028	思源电气	12,015	190,918.35	0.00
243	000931	中关村	14,900	189,230.00	0.00
244	600765	中航重机	9,600	188,544.00	0.00
245	600859	王府井	6,900	187,818.00	0.00
246	000975	银泰资源	15,000	187,800.00	0.00
247	002254	泰和新材	11,800	187,502.00	0.00
248	000786	北新建材	15,650	186,235.00	0.00
249	600426	华鲁恒升	12,900	186,147.00	0.00
250	000969	安泰科技	14,300	185,614.00	0.00
251	601311	骆驼股份	8,500	185,555.00	0.00
252	000088	盐田港	21,500	185,330.00	0.00
253	002025	航天电器	7,100	184,529.00	0.00

254	600267	海正药业	11,600	183,860.00	0.00
255	600808	马钢股份	58,201	183,333.15	0.00
256	600039	四川路桥	35,740	182,274.00	0.00
257	002106	莱宝高科	13,620	181,690.80	0.00
258	600270	外运发展	6,700	181,302.00	0.00
259	600289	亿阳信通	9,200	181,240.00	0.00
260	000528	柳工	21,755	180,348.95	0.00
261	002093	国脉科技	12,000	178,560.00	0.00
262	000636	风华高科	15,600	177,996.00	0.00
263	000612	焦作万方	23,300	177,779.00	0.00
264	002479	富春环保	13,200	176,880.00	0.00
265	002251	步步高	10,759	175,371.70	0.00
266	600187	国中水务	28,100	174,501.00	0.00
267	000869	张裕 A	3,800	173,964.00	0.00
268	600067	冠城大通	19,900	173,926.00	0.00
269	600175	美都能源	24,000	173,520.00	0.00
270	000099	中信海直	11,700	172,926.00	0.00
271	600872	中炬高新	11,000	172,150.00	0.00
272	600894	广日股份	8,600	171,914.00	0.00
273	600428	中远航运	16,700	171,342.00	0.00
274	000550	江铃汽车	5,700	170,886.00	0.00
275	002029	七匹狼	12,500	170,875.00	0.00
276	600351	亚宝药业	10,864	169,695.68	0.00
277	002155	湖南黄金	18,800	169,012.00	0.00
278	600805	悦达投资	13,302	168,403.32	0.00
279	600580	卧龙电气	10,900	168,078.00	0.00
280	000726	鲁泰 A	12,400	167,648.00	0.00
281	600433	冠豪高新	14,500	166,170.00	0.00
282	600970	中材国际	13,900	166,105.00	0.00
283	600557	康缘药业	6,600	165,132.00	0.00
284	000417	合肥百货	15,100	165,043.00	0.00
285	002698	博实股份	5,610	164,541.30	0.00
286	000900	现代投资	19,600	164,444.00	0.00
287	002041	登海种业	9,700	163,445.00	0.00
288	600220	江苏阳光	28,400	163,016.00	0.00
289	002358	森源电气	8,800	162,360.00	0.00
290	000401	冀东水泥	14,860	161,974.00	0.00
291	002317	众生药业	12,200	161,528.00	0.00
292	002342	巨力索具	21,200	161,332.00	0.00

293	600086	东方金钰	13,100	161,261.00	0.00
294	000982	中银绒业	34,738	161,184.32	0.00
295	600125	铁龙物流	17,500	160,825.00	0.00
296	000631	顺发恒业	16,200	160,704.00	0.00
297	002056	横店东磁	5,700	160,227.00	0.00
298	600056	中国医药	9,623	160,030.49	0.00
299	000620	新华联	15,700	158,727.00	0.00
300	002078	太阳纸业	28,000	157,640.00	0.00
301	000933	神火股份	31,500	156,870.00	0.00
302	000501	鄂武商 A	7,300	156,220.00	0.00
303	601880	大连港	26,200	156,152.00	0.00
304	600216	浙江医药	12,600	155,862.00	0.00
305	600292	中电远达	7,500	155,100.00	0.00
306	600885	宏发股份	5,147	153,843.83	0.00
307	002354	天神娱乐	1,600	153,568.00	0.00
308	002332	仙琚制药	10,100	153,015.00	0.00
309	002203	海亮股份	13,900	152,900.00	0.00
310	600366	宁波韵升	7,000	152,880.00	0.00
311	600062	华润双鹤	6,700	152,827.00	0.00
312	002277	友阿股份	11,000	152,790.00	0.00
313	600628	新世界	8,413	152,191.17	0.00
314	002237	恒邦股份	15,100	150,698.00	0.00
315	600348	阳泉煤业	23,300	150,518.00	0.00
316	000669	金鸿能源	6,696	149,521.68	0.00
317	002663	普邦园林	18,800	149,272.00	0.00
318	603369	今世缘	4,450	149,208.50	0.00
319	002281	光迅科技	2,300	149,109.00	0.00
320	600284	浦东建设	10,873	148,851.37	0.00
321	000418	小天鹅 A	6,128	147,072.00	0.00
322	600416	湘电股份	7,000	145,110.00	0.00
323	002233	塔牌集团	9,900	145,035.00	0.00
324	000919	金陵药业	8,373	144,015.60	0.00
325	300043	互动娱乐	9,100	143,780.00	0.00
326	600260	凯乐科技	9,600	143,424.00	0.00
327	002327	富安娜	11,900	143,157.00	0.00
328	600481	双良节能	15,800	143,148.00	0.00
329	600183	生益科技	14,400	142,416.00	0.00
330	002293	罗莱家纺	7,800	142,272.00	0.00
331	000030	富奥股份	13,900	141,780.00	0.00

332	600614	鼎立股份	12,100	140,723.00	0.00
333	000693	华泽钴镍	7,500	139,725.00	0.00
334	002371	七星电子	7,200	138,816.00	0.00
335	603188	亚邦股份	6,200	138,756.00	0.00
336	600409	三友化工	17,901	138,732.75	0.00
337	002118	紫鑫药业	7,103	138,579.53	0.00
338	600750	江中药业	3,900	137,631.00	0.00
339	600006	东风汽车	15,500	137,330.00	0.00
340	600073	上海梅林	9,700	137,255.00	0.00
341	600812	华北制药	15,900	136,899.00	0.00
342	600180	瑞茂通	6,200	136,896.00	0.00
343	002122	天马股份	16,400	136,612.00	0.00
344	000877	天山股份	17,000	136,510.00	0.00
345	600458	时代新材	7,700	136,290.00	0.00
346	002503	搜于特	8,600	136,224.00	0.00
347	600757	长江传媒	12,400	136,152.00	0.00
348	600460	士兰微	15,200	134,520.00	0.00
349	600993	马应龙	6,095	134,211.90	0.00
350	600112	天成控股	8,000	134,080.00	0.00
351	600298	安琪酵母	4,400	133,848.00	0.00
352	600004	白云机场	9,400	133,762.00	0.00
353	603077	和邦生物	19,700	132,581.00	0.00
354	601010	文峰股份	17,800	129,406.00	0.00
355	002392	北京利尔	16,600	129,148.00	0.00
356	600850	华东电脑	2,500	129,125.00	0.00
357	600280	中央商场	11,500	128,455.00	0.00
358	603019	中科曙光	1,400	127,638.00	0.00
359	601801	皖新传媒	3,900	127,452.00	0.00
360	601005	重庆钢铁	38,431	126,437.99	0.00
361	600586	金晶科技	20,500	125,255.00	0.00
362	600823	世茂股份	10,220	124,990.60	0.00
363	002315	焦点科技	1,300	124,813.00	0.00
364	600282	南钢股份	39,300	124,581.00	0.00
365	600826	兰生股份	3,605	124,156.20	0.00
366	601777	力帆股份	7,100	123,114.00	0.00
367	600496	精工钢构	20,400	122,604.00	0.00
368	600831	广电网络	7,600	120,156.00	0.00
369	000703	恒逸石化	10,800	119,988.00	0.00
370	600825	新华传媒	10,037	119,841.78	0.00

371	601886	江河创建	9,500	119,795.00	0.00
372	002635	安洁科技	4,300	119,540.00	0.00
373	600790	轻纺城	14,700	119,511.00	0.00
374	600392	盛和资源	9,700	119,407.00	0.00
375	600566	济川药业	4,300	118,938.00	0.00
376	002408	齐翔腾达	8,900	118,459.00	0.00
377	600300	维维股份	16,500	118,305.00	0.00
378	600720	祁连山	13,300	117,439.00	0.00
379	000596	古井贡酒	3,200	116,800.00	0.00
380	600748	上实发展	8,700	116,754.00	0.00
381	600545	新疆城建	10,500	116,235.00	0.00
382	601515	东风股份	7,000	116,060.00	0.00
383	002267	陕天然气	9,200	115,920.00	0.00
384	600337	美克家居	7,400	115,588.00	0.00
385	600761	安徽合力	8,600	114,810.00	0.00
386	600869	智慧能源	12,000	114,600.00	0.00
387	002646	青青稞酒	5,000	114,100.00	0.00
388	601002	晋亿实业	9,800	112,994.00	0.00
389	601369	陕鼓动力	12,600	110,124.00	0.00
390	600251	冠农股份	9,700	109,610.00	0.00
391	600236	桂冠电力	14,600	109,208.00	0.00
392	601678	滨化股份	13,600	109,072.00	0.00
393	600563	法拉电子	2,600	108,186.00	0.00
394	600596	新安股份	10,600	108,120.00	0.00
395	600639	浦东金桥	4,800	107,472.00	0.00
396	600773	西藏城投	5,900	107,380.00	0.00
397	600575	皖江物流	17,300	107,087.00	0.00
398	002204	大连重工	10,700	107,000.00	0.00
399	601666	平煤股份	22,700	105,782.00	0.00
400	600395	盘江股份	12,800	105,088.00	0.00
401	601126	四方股份	7,900	104,912.00	0.00
402	002140	东华科技	4,900	104,370.00	0.00
403	002493	荣盛石化	6,726	104,253.00	0.00
404	600509	天富能源	10,600	103,986.00	0.00
405	002194	武汉凡谷	6,100	103,700.00	0.00
406	600022	山东钢铁	33,300	103,563.00	0.00
407	600551	时代出版	4,500	102,375.00	0.00
408	002216	三全食品	8,900	101,371.00	0.00
409	600184	光电股份	3,500	101,185.00	0.00

410	600657	信达地产	14,500	100,775.00	0.00
411	600026	中海发展	10,800	99,792.00	0.00
412	601908	京运通	12,100	99,462.00	0.00
413	600259	广晟有色	2,500	99,000.00	0.00
414	600743	华远地产	14,600	98,988.00	0.00
415	600059	古越龙山	9,000	98,910.00	0.00
416	600141	兴发集团	6,600	96,492.00	0.00
417	600809	山西汾酒	5,000	96,350.00	0.00
418	601233	桐昆股份	7,300	95,995.00	0.00
419	002238	天威视讯	4,300	95,460.00	0.00
420	000921	海信科龙	10,000	95,300.00	0.00
421	600425	青松建化	16,300	95,192.00	0.00
422	600803	新奥股份	6,000	95,160.00	0.00
423	000525	红太阳	5,600	94,864.00	0.00
424	600874	创业环保	8,700	91,785.00	0.00
425	601001	大同煤业	16,500	91,575.00	0.00
426	600617	国新能源	5,900	90,447.00	0.00
427	002419	天虹商场	6,600	89,100.00	0.00
428	603328	依顿电子	3,000	88,530.00	0.00
429	600537	亿晶光电	5,900	88,382.00	0.00
430	603699	纽威股份	4,045	88,261.90	0.00
431	600546	山煤国际	19,700	87,271.00	0.00
432	600329	中新药业	4,100	86,838.00	0.00
433	002461	珠江啤酒	5,601	85,527.27	0.00
434	600776	东方通信	7,300	83,512.00	0.00
435	000951	中国重汽	4,600	83,260.00	0.00
436	600483	福能股份	4,800	82,512.00	0.00
437	603555	贵人鸟	2,300	81,489.00	0.00
438	000852	石化机械	3,800	81,168.00	0.00
439	600510	黑牡丹	6,608	79,494.24	0.00
440	600397	安源煤业	13,600	79,424.00	0.00
441	002430	杭氧股份	6,900	79,350.00	0.00
442	601139	深圳燃气	8,700	79,170.00	0.00
443	600195	中牧股份	3,700	79,106.00	0.00
444	601101	昊华能源	10,000	78,600.00	0.00
445	600640	号百控股	3,697	78,413.37	0.00
446	600088	中视传媒	2,600	78,286.00	0.00
447	603883	老百姓	1,100	78,067.00	0.00
448	600335	国机汽车	4,109	77,002.66	0.00

449	002128	露天煤业	9,000	76,050.00	0.00
450	002249	大洋电机	5,700	75,582.00	0.00
451	600456	宝钛股份	3,700	75,110.00	0.00
452	603169	兰石重装	4,096	74,752.00	0.00
453	603001	奥康国际	2,200	73,964.00	0.00
454	600132	重庆啤酒	4,500	71,955.00	0.00
455	002648	卫星石化	6,600	71,346.00	0.00
456	600997	开滦股份	12,700	70,866.00	0.00
457	603005	晶方科技	1,400	70,420.00	0.00
458	603366	日出东方	6,600	69,960.00	0.00
459	600468	百利电气	3,900	69,108.00	0.00
460	000973	佛塑科技	5,300	68,900.00	0.00
461	601965	中国汽研	7,300	68,547.00	0.00
462	600780	通宝能源	9,362	66,376.58	0.00
463	000719	大地传媒	3,220	65,688.00	0.00
464	600618	氯碱化工	3,977	64,188.78	0.00
465	000552	靖远煤电	6,300	63,504.00	0.00
466	600507	方大特钢	10,300	62,830.00	0.00
467	603567	珍宝岛	1,200	62,160.00	0.00
468	600751	天海投资	6,300	60,606.00	0.00
469	600161	天坛生物	1,700	59,381.00	0.00
470	600971	恒源煤电	9,412	59,201.48	0.00
471	002745	木林森	1,400	57,302.00	0.00
472	600917	重庆燃气	3,600	54,684.00	0.00
473	000582	北部湾港	2,400	54,024.00	0.00
474	601226	华电重工	4,150	52,497.50	0.00
475	603698	航天工程	1,200	42,060.00	0.00
476	600801	华新水泥	4,300	35,045.00	0.00
477	603806	福斯特	600	29,994.00	0.00
478	603899	晨光文具	700	29,442.00	0.00
479	603589	口子窖	600	25,764.00	0.00
480	603568	伟明环保	300	15,210.00	0.00
481	603025	大豪科技	300	12,273.00	0.00
482	600880	博瑞传播	900	10,233.00	0.00
483	603355	莱克电气	100	4,670.00	0.00
484	002678	珠江钢琴	67	1,153.07	0.00
485	000748	长城信息	32	1,116.16	0.00



## 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	600895	张江高科	21,608,851.25	0.54
2	601718	际华集团	21,432,562.93	0.54
3	600635	大众公用	20,539,944.64	0.52
4	600201	生物股份	19,616,298.40	0.49
5	600601	方正科技	19,142,928.02	0.48
6	600037	歌华有线	18,906,333.66	0.47
7	600655	豫园商城	18,287,413.50	0.46
8	600737	中粮屯河	17,883,965.98	0.45
9	600079	人福医药	17,634,489.17	0.44
10	600158	中体产业	17,544,151.00	0.44
11	600881	亚泰集团	17,396,670.43	0.44
12	600021	上海电力	17,063,078.70	0.43
13	600435	北方导航	16,430,463.25	0.41
14	600410	华胜天成	16,398,427.87	0.41
15	601012	隆基股份	15,891,979.45	0.40
16	600525	长园集团	15,102,387.77	0.38
17	600816	安信信托	14,673,248.91	0.37
18	600320	振华重工	14,549,964.30	0.37
19	600160	巨化股份	14,027,211.58	0.35
20	600811	东方集团	13,999,990.42	0.35

注：买入包括二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票，买入金额按成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

### 8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	600635	大众公用	21,132,078.39	0.53
2	600525	长园集团	20,840,429.67	0.52
3	600037	歌华有线	20,005,461.31	0.50
4	600601	方正科技	19,806,532.52	0.50

5	600201	生物股份	19,648,920.17	0.49
6	600895	张江高科	19,097,525.28	0.48
7	600881	亚泰集团	18,388,160.46	0.46
8	600158	中体产业	18,112,829.87	0.45
9	600704	物产中大	16,908,715.67	0.42
10	600435	北方导航	16,835,630.00	0.42
11	601718	际华集团	16,744,558.73	0.42
12	601012	隆基股份	15,904,622.23	0.40
13	600694	大商股份	15,635,416.21	0.39
14	601099	太平洋	15,631,663.91	0.39
15	600584	长电科技	15,087,404.25	0.38
16	600811	东方集团	15,033,529.20	0.38
17	600169	太原重工	14,923,137.52	0.37
18	600737	中粮屯河	14,795,089.39	0.37
19	600320	振华重工	14,758,721.70	0.37
20	600240	华业资本	14,670,661.03	0.37

注：卖出包括二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票，卖出金额按成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	2,729,710,524.90
卖出股票收入（成交）总额	2,856,553,181.65

注：买入股票成本、卖出股票收入均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

#### 8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

#### 8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

## 8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

## 8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

## 8.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

金额单位：人民币元

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	500ETF	股票型	ETF	南方基金管理有限公司	5,304,357,531.23	93.03

## 8.11 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期内未投资股指期货。

## 8.12 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期内未投资国债期货。

## 8.13 投资组合报告附注

### 8.13.1

本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

### 8.13.2

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

### 8.13.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	2,001,495.02
2	应收证券清算款	534,124.80
3	应收股利	1,691.14
4	应收利息	60,591.71
5	应收申购款	20,143,076.75
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	9,310,637.34
9	合计	32,051,616.76

### 8.13.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 8.13.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	600978	宜华木业	2,632,707.00	0.05	重大资产重组
2	600654	中安消	1,612,156.00	0.03	重大事项停牌
3	600729	重庆百货	936,320.00	0.02	重大资产重组
4	002049	同方国芯	725,409.00	0.01	重大资产重组
5	601717	郑煤机	702,368.00	0.01	重大资产重组

## § 9 基金份额持有人信息

### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
315,068	10,023.06	1,217,051,677.23	38.54%	1,940,894,747.54	61.46%

### 9.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额 (份)	占上市总份额 比例
1	薛宜平	530,282.00	0.02%
2	姚红伟	529,900.00	0.02%
3	牟子豪	515,900.00	0.02%
4	王少琴	515,053.00	0.02%
5	蔡伟岗	394,487.00	0.01%
6	栾荣华	300,000.00	0.01%
7	毛新程	280,000.00	0.01%
8	翟建忠	268,502.00	0.01%
9	张振华	250,000.00	0.01%
10	袁文华	208,178.00	0.01%

### 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	3,026,695.62	0.0958%

### 9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间 (万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	0~10

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日 (2009 年 9 月 25 日) 基金份额总额	3,223,217,818.45
本报告期期初基金份额总额	3,178,886,245.80
本报告期基金总申购份额	5,075,913,707.99
减:本报告期基金总赎回份额	5,096,853,529.02
本报告期基金拆分变动份额 (份额减少以“-”填列)	-
本报告期期末基金份额总额	3,157,946,424.77

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

### 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

根据南方基金管理有限公司第六届董事会第十四次会议审议通过，并向中国基金业协会报备，基金管理人于 2015 年 5 月 29 日发布公告，聘任常克川、李海鹏为公司副总经理。

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门没有发生重大人事变动。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 11.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未改变。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期未变更会计师事务所。本年度支付给普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)审计费用 103,000 元，该审计机构已提供审计服务的连续年限为 7 年。

### 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人、基金托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
国泰君安		13,878,326,663.07	69.44%	3,580,685.43	82.76%	-
华泰证券		11,389,150,677.14	24.87%	457,238.73	10.57%	-
中泰证券 (原齐鲁证券)	1	317,319,833.98	5.68%	288,887.44	6.68%	-
日信证券	1	-	-	-	-	-
英大证券	2	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
高华证券	1	-	-	-	-	-
江海证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	2	-	-	-	-	-
中天证券	1	-	-	-	-	-

注：根据中国证监会《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》(证监基金字[2007]48号)的有关规定，我公司制定了租用证券公司交易单元的选择标准和程序：

A：选择标准

- a、公司经营行为规范，财务状况和经营状况良好；
- b、公司具有较强的研究能力，能及时、全面地为基金提供高质量的宏观经济研究、行业研究及市场走向、个股分析报告和专门研究报告；
- c、公司内部管理规范，能满足基金操作的保密要求；
- d、建立了广泛的信息网络，能及时提供准确的信息资讯服务。

#### B: 选择流程

公司研究部门定期对券商服务质量从以下几方面进行量化评比，并根据评比的结果选择交易单元：

- a、服务的主动性。主要针对证券公司承接调研课题的态度、协助安排上市公司调研、以及就有关专题提供研究报告和讲座；
- b、研究报告的质量。主要是指证券公司所提供研究报告是否详实，投资建议是否准确；
- c、资讯提供的及时性及便利性。主要是指证券公司提供资讯的时效性、及时性以及提供资讯的渠道是否便利、提供的资讯是否充足全面。

## 11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	关于公司旗下基金调整停牌股票估值方法的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 1 月 22 日
2	南方中证 500ETF 联接(LOF)2014 年第 4 季度报告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 1 月 22 日
3	关于公司旗下基金调整停牌股票估值方法的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 1 月 23 日
4	南方基金关于旗下部分基金参加浦发银行基金定投申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 2 月 9 日
5	南方基金关于旗下部分基金增加中金公司为代销机构及开通转换业务并参与其费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 2 月 11 日
6	南方基金关于旗下部分基金增加海银基金为代销机构及开通定投业务并参与其费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 2 月 12 日
7	南方基金管理有限公司关于从业人员在子公司兼任职务情况的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 2 月 12 日
8	南方基金管理有限公司关于调整旗下部分基金最低赎回限额的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 2 月 25 日
9	关于公司旗下基金调整停牌股票估值方法的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 2 月 28 日
10	关于公司旗下基金调整停牌股票估值方法的	中国证券报、上海	2015 年 3 月 5 日

	提示性公告	证券报、证券时报	
11	关于公司旗下基金调整停牌股票估值方法的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 3 月 17 日
12	南方基金管理有限公司关于旗下基金调整交易所固定收益品种估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 3 月 17 日
13	关于公司旗下基金调整停牌股票估值方法的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 3 月 19 日
14	关于公司旗下基金调整停牌股票估值方法的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 3 月 20 日
15	南方基金关于旗下部分基金增加联泰资产为代销机构及开通定投和转换业务并参与其费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 3 月 23 日
16	关于公司旗下基金调整停牌股票估值方法的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 3 月 26 日
17	南方中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF)2014 年度报告(摘要)	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 3 月 26 日
18	南方中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF)2014 年度报告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 3 月 26 日
19	南方基金关于旗下部分基金增加增财基金为代销机构及开通定投和转换业务并参与其费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 3 月 31 日
20	南方基金关于旗下部分基金参加中国工商银行个人电子银行基金申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 4 月 1 日
21	关于公司旗下基金调整停牌股票估值方法的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 4 月 2 日
22	南方基金关于网上直销汇款交易申购旗下部分基金费率为 0 的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 4 月 2 日
23	关于公司旗下基金调整停牌股票估值方法的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 4 月 8 日
24	南方基金关于淘宝直营店销售手续费费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 4 月 10 日
25	关于电子直销业务增加苏宁易购第三方支付业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 4 月 15 日
26	南方基金管理有限公司关于旗下部分指数型基金开展赎回费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 4 月 16 日
27	南方基金关于旗下部分基金增加河北银行为代销机构及开通定投和转换业务并参与其费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 4 月 17 日
28	南方基金管理有限公司关于从业人员在子公司兼任职务情况的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 4 月 18 日
29	南方中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF)2015 年第 1 季度报告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 4 月 21 日
30	南方基金管理有限公司关于公司高级管理人员	中国证券报、上海	2015 年 4 月 23 日



	员在子公司兼职情况变更的公告	证券报、证券时报	
31	南方基金管理有限公司深圳分公司负责人等信息变更的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 4 月 28 日
32	南方基金管理有限公司关于旗下基金投资资产支持证券的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 5 月 7 日
33	南方基金关于旗下部分基金增加创金启富为代销机构及开通定投业务并参与其费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 5 月 11 日
34	关于公司旗下基金调整停牌股票估值方法的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 5 月 13 日
35	南方基金关于旗下部分基金增加新兰德为代销机构并参与其费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 5 月 18 日
36	关于公司旗下基金调整停牌股票估值方法的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 5 月 20 日
37	关于公司旗下基金调整停牌股票估值方法的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 5 月 22 日
38	关于公司旗下基金调整停牌股票估值方法的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 5 月 26 日
39	关于公司旗下基金调整停牌股票估值方法的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 5 月 27 日
40	关于公司旗下基金调整停牌股票估值方法的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 5 月 28 日
41	南方基金管理有限公司关于副总经理变更的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 5 月 29 日
42	南方基金关于旗下部分基金增加宜信普泽为代销机构及开通定投业务并参与其费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 6 月 1 日
43	南方基金关于旗下部分基金参加中国农业银行网上银行、手机银行申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 6 月 1 日
44	南方基金关于电子直销平台开通货币基金快速转购业务并实行 0 费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 6 月 8 日
45	关于公司旗下基金调整停牌股票估值方法的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 6 月 12 日
46	关于公司旗下基金调整停牌股票估值方法的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 6 月 27 日
47	南方基金关于旗下部分基金参加交通银行网上银行、手机银行基金申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 6 月 30 日
48	关于公司旗下基金调整停牌股票估值方法的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 7 月 4 日
49	关于公司旗下基金调整停牌股票估值方法的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 7 月 8 日
50	关于京东电子交易平台实施费率优惠的公告	中国证券报、上海	2015 年 7 月 9 日

		证券报、证券时报	
51	关于公司旗下基金调整停牌股票估值方法的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 7 月 10 日
52	关于公司旗下基金调整停牌股票估值方法的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 7 月 11 日
53	关于公司旗下基金调整停牌股票估值方法的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 7 月 14 日
54	南方基金关于电子直销平台相关业务调整费率优惠方案的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 7 月 15 日
55	南方基金关于旗下部分基金增加汇付金融为代销机构及开通定投业务并参与其费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 7 月 20 日
56	南方中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF)2015 年第 2 季度报告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 7 月 20 日
57	关于公司旗下基金调整停牌股票估值方法的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 7 月 24 日
58	南方基金关于旗下部分基金增加江南农村商业银行、第一创业、大连银行、青岛银行和包	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 7 月 30 日
59	南方基金关于旗下部分基金增加天风证券为代销机构及开通定投和转换业务公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 7 月 31 日
60	南方基金关于旗下部分基金增加中信建投期货为代销机构及通定投和转换业务并参与其费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 8 月 3 日
61	南方基金关于旗下部分基金参加浦发银行网上银行、手机银行申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 8 月 3 日
62	关于注意防范冒用南方基金名义进行的非法证券活动的提示	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 8 月 7 日
63	南方基金关于旗下部分基金增加诺亚正行为代销机构及开通定投业务并参与其费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 8 月 10 日
64	关于修订公司旗下开放式指数基金基金合同有关基金关联交易限制等投资限制条款的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 8 月 12 日
65	关于公司旗下基金调整停牌股票估值方法的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 8 月 22 日
66	南方中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF)2015 年半年度报告(摘要)	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 8 月 25 日
67	南方中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF)2015 年半年度报告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 8 月 25 日
68	关于公司旗下基金调整停牌股票估值方法的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 8 月 25 日
69	关于公司旗下基金调整停牌股票估值方法的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 8 月 26 日
70	南方基金管理有限公司关于公司旗下开放式	中国证券报、上海	2015 年 9 月 12 日

	基金变更代销机构的公告	证券报、证券时报	
71	关于公司旗下基金调整停牌股票估值方法的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 9 月 16 日
72	关于公司旗下基金调整停牌股票估值方法的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 9 月 22 日
73	南方基金关于旗下部分基金增加中信期货为代销机构及开通定投和转换业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 9 月 23 日
74	南方基金关于继续开展直销柜台部分指数型基金赎回费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 10 月 14 日
75	南方基金关于旗下部分基金增加盈米财富为代销机构及开通定投和转换业务并参与其费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 10 月 16 日
76	南方基金关于旗下部分基金增加南商（中国）为代销机构及开通定投和转换业务并参与其费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 10 月 26 日
77	南方中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF)2015 年第 3 季度报告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 10 月 27 日
78	南方基金关于旗下部分基金增加泉州银行为代销机构及开通定投和转换业务并参与其费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 11 月 4 日
79	关于南方中证 500 联接基金在财付通支付科技有限公司“理财通”平台开展申购费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 11 月 5 日
80	关于公司旗下基金调整停牌股票估值方法的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 11 月 5 日
81	南方基金关于电子直销平台相关业务调整费率优惠方案的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 11 月 9 日
82	南方基金关于旗下部分基金增加陆金所资管为代销机构并参与其费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 11 月 9 日
83	南方基金管理有限公司关于降低旗下部分开放式基金申购最低金额限制的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 11 月 9 日
84	关于电子直销业务调整通联支付申购优惠费率的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 11 月 23 日
85	南方基金关于旗下部分基金增加富济财富为代销机构及开通定投和转换业务并参与其费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 11 月 24 日
86	关于公司旗下基金调整停牌股票估值方法的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 11 月 25 日
87	关于公司旗下基金调整停牌股票估值方法的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 11 月 26 日
88	南方基金关于旗下部分基金增加唐鼎耀华为代销机构及开通定投和转换业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 11 月 30 日
89	关于京东电子交易平台实施费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 12 月 4 日

90	南方基金关于旗下部分基金增加凯石财富为代销机构及开通定投和转换业务并参与其费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 12 月 8 日
91	南方基金关于旗下部分基金增加大泰金石为代销机构及开通转换业务并参与其费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 12 月 11 日
92	南方基金关于旗下部分基金增加济安财富为代销机构及开通定投和转换业务并参与其费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 12 月 17 日
93	南方基金关于旗下部分基金增加利得基金为代销机构及开通定投业务并参与其费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 12 月 23 日
94	关于南方中证 500ETF 联接基金在财付通支付科技有限公司“理财通”平台开展申购费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 12 月 24 日
95	南方基金关于电子直销平台相关业务调整费率优惠方案的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 12 月 29 日
96	南方基金关于继续开展直销柜台部分指数型基金申购费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 12 月 31 日
97	南方基金关于旗下部分基金参加浦发银行基金定投申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 12 月 31 日
98	南方基金关于旗下部分基金参加邮储银行个人网上银行和手机银行基金申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 12 月 31 日
99	南方基金关于旗下部分基金参加中国工商银行基金定投优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 12 月 31 日
100	南方基金关于旗下部分基金参加中国光大银行电子渠道基金定投申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 12 月 31 日
101	南方基金关于旗下部分基金参加中国农业银行基金定投、基金组合申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2015 年 12 月 31 日

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准设立南方中证 500 指数证券投资基金的文件。
- 2、南方中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金（LOF）基金合同。
- 3、南方中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金（LOF）托管协议。
- 4、中国证监会批准设立南方基金管理有限公司的文件。
- 5、报告期内在选定报刊上披露的各项公告。

## 12.2 存放地点

深圳市福田区福华一路 6 号免税商务大厦 31-33 楼

## 12.3 查阅方式

网站: <http://www.nffund.com>